

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHİ İTİBARIYLA
PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK
DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA
UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR



**TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş. Pera 2 Değişken Grup Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Fon'un Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Türkiye Hayat ve Emeklilik A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.



Ramazan Yüksekaya, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 1 Nisan 2024

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-4
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	5

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.

PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanım	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
HISSE SENETLERİ																
Hisse Türk																
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYİ A.Ş.	-	AEFES	-	-	6.200	197,2223	19/12/23	-	-	-	137,50	-	852.500	3,40	1,34
	AKBANK T.A.Ş.	-	AKBNK	-	-	43.249	23,4209	19/12/23	-	-	-	36,52	-	1.579.453	6,29	2,48
	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET AŞ	-	ASELS	-	-	17.899	39,0148	19/12/23	-	-	-	44,98	-	805.097	3,21	1,26
	COCA COLA ICECEK A.Ş.	-	CCOLA	-	-	2.250	372,1873	19/12/23	-	-	-	525,50	-	1.182.375	4,71	1,86
	DOĞUŞ OTOM.SERVİS VE TİC.A.Ş.	-	DOAS	-	-	2.850	275,1406	19/12/23	-	-	-	257,00	-	732.450	2,92	1,15
	EMLAK KONUT GAYR.YAT.ORT.A.Ş.	-	EKGYO	-	-	97.000	8,6091	19/12/23	-	-	-	6,88	-	667.360	2,66	1,05
	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.	-	ENKAI	-	-	29.750	51,9815	19/12/23	-	-	-	34,00	-	1.011.500	4,03	1,59
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAB.T.A.Ş.	-	EREGL	-	-	26.500	60,8532	19/12/23	-	-	-	41,00	-	1.086.500	4,33	1,71
	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.	-	FROTO	-	-	800	607,1940	19/12/23	-	-	-	739,50	-	591.600	2,36	0,93
	T.GARANTİ BANKASI A.Ş.	-	GARAN	-	-	17.000	43,1079	19/12/23	-	-	-	58,35	-	991.950	3,95	1,56
	TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.	-	ISCTR	-	-	0	22,3500	23/10/23	-	-	-	23,36	-	9	0,00	0,00
	KOZA ALTIN İŞL.A.Ş.	-	KOZAL	-	-	34.150	24,2020	19/12/23	-	-	-	19,53	-	666.950	2,66	1,05
	MAVİ GİYİM SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	MAVI	-	-	8.000	46,0614	19/12/23	-	-	-	116,50	-	932.000	3,71	1,46
	Oyak Çimento Fabrikalar	-	OYAKC	-	-	9.700	69,0604	19/12/23	-	-	-	55,45	-	537.865	2,14	0,84
	TÜRKİYE ŞİŞE CAM VE FAB.A.Ş.	-	SISE	-	-	0	47,4286	23/10/23	-	-	-	45,82	-	3	0,00	0,00
	ŞOK MARKETLER TİCARET A.Ş	-	SOKM	-	-	14.500	33,8460	19/12/23	-	-	-	53,95	-	782.275	3,12	1,23
	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZM.A.Ş.	-	TCELL	-	-	18.100	42,3828	19/12/23	-	-	-	56,10	-	1.015.410	4,05	1,59
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	-	THYAO	-	-	9.150	163,2552	19/12/23	-	-	-	228,60	-	2.091.690	8,36	3,28
	TORUNLAR GAYRİMENKUL YAT.ORT.A.Ş.	-	TRGYO	-	-	33.000	20,6552	19/12/23	-	-	-	31,70	-	1.046.100	4,17	1,64
	T.SINAI KALKINMA BANKASI A.Ş.	-	TSKB	-	-	116.000	5,0071	19/12/23	-	-	-	6,55	-	759.800	3,03	1,19
	TÜPRAS TÜRKİYE PETROL RAFİNERİ A.Ş.	-	TUPRS	-	-	12.150	85,8168	19/12/23	-	-	-	143,00	-	1.737.450	6,92	2,73
	VESTEL BEYAZ ESYA SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESBE	-	-	43.000	15,6430	19/12/23	-	-	-	16,00	-	688.000	2,74	1,08
	VESTEL ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.S.	-	VESTL	-	-	21.200	55,5850	19/12/23	-	-	-	46,24	-	980.288	3,91	1,54
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.S.	-	YKBNK	-	-	92.000	18,0744	19/12/23	-	-	-	19,54	-	1.797.682	7,16	2,82
	AKÇANSA ÇİMENTO SANAYİ VE TİCARET A.Ş.	-	AKCNS	-	-	4.800	76,5135	19/12/23	-	-	-	142,30	-	683.040	2,72	1,07
	ARSAN TEKSTİL TİCARET VE SANAYİ A.Ş	-	ARSAN	-	-	0	3,6667	28/09/22	-	-	-	10,32	-	0	0,00	0,00

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş	-	BIMAS	-	-	4.100	127,2329	15/09/23	-	-	-	300,75	-	1.233.075	4,91	1,94
	OTOKAR OTOMOTİV VE SAVUNMA SANAYİ A.Ş	-	OTKAR	-	-	1.500	406,9945	23/10/23	-	-	-	425,50	-	638.250	2,54	1,00
GRUP TOPLAMI						664.849								25.090.673	100,00	39,39
BORÇLANMA SENETLERİ																
Özel Sektör																
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYİ A.S.	18/01/24	TRSEFES12413	35,44	-	1.110.000	100,0000	22/12/22	32,6404	-	-	133,77	-	1.484.895	16,75	2,33
	ENERJISA ENERJİ A.Ş	18/10/24	TRSENSAE2429	4,40	-	240.000	100,0000	21/10/22	39,4984	-	-	111,33	-	267.182	3,01	0,42
	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O	06/09/27	TRSVKFB92719	13,96	-	500.000	100,0000	18/09/17	30,9468	-	-	101,67	-	508.363	5,73	0,80
ARA GRUP TOPLAMI						1.850.000								2.260.441	25,49	3,55
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet																
	FİBABANKA ÜÇÜNCÜ VARLIK FİNANSMANI FONU (VFF)	20/08/24	TRPFB3F82411	36,71	-	3.310.000	100,0000	14/12/23	57,8587	-	-	102,40	-	3.389.603	38,25	5,32
ARA GRUP TOPLAMI						3.310.000								3.389.603	38,25	5,32
GRUP TOPLAMI						5.160.000								5.650.044	63,74	8,87
TPP																
	TPP	02/01/24	-	43,05	-	4.018.871	43,0500	29/12/23	-	-	4.018.871	42,59	-	4.018.871	100,00	6,31
GRUP TOPLAMI						4.018.871								4.018.871	100,00	6,31

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutarı	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
VIOP Nakit Teminatı																
		-	-	VIOP Nakit Teminatı	-	-	18.401.825	-	-	-	-	-	-	18.401.825	100,00	28,63
GRUP TOPLAMI						18.401.825								18.401.825	100,00	28,63
VIOP USD Nakit Teminatı																
		-	-	VIOP USD Nakit Teminatı	-	-	268.192	-	-	-	-	-	-	7.895.090	100,00	0,42
GRUP TOPLAMI						268.192								7.895.090	100,00	0,42
DİĞER																
Döviz																
	ABD HAZİNE	-	USD	-	-	268.192	28,4890	29/12/23	-	-	-	29,44	-	7.895.090	0,00	12,40
GRUP TOPLAMI						268.192								7.895.090	0,00	12,40
KİRA SERTİFİKALARI																
Kamu Kesimi Kira Sertifikaları																
	HAZINE	03/12/25	TRD031225T10	0,00	-	10.000	90,6271	31/12/21	23,6319	-	-	87,27	-	8.727	0,10	0,01
ARA GRUP TOPLAMI						10.000								8.727	0,10	0,01
Özel Sektör Kira Sertifikaları																
	MLP SAĞLIK HİZMETLERİ A.Ş.	12/06/25	TRDYVKS62511	76,54	-	3.120.000	100,0000	12/12/23	60,1851	-	-	102,75	-	3.205.733	36,16	5,03
ARA GRUP TOPLAMI						3.120.000								3.205.733	36,16	5,03

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ FİYAT RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo Teminat Tutar	Net Dönüş Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup (%)	Toplam (%)
GRUP TOPLAMI						3.130.000								3.214.460	36,26	5,04
FON PORTFÖY DEĞERİ														64.270.963		88,13

TÜRKİYE HAYAT VE EMEKLİLİK A.Ş.
PERA 2 DEĞİŞKEN GRUP EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2023 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2023		Toplam %
	Tutar TL	Grup %	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	64.270.963	-	100,92
B. HAZIR DEĞERLER	111.319	-	0,17
a) Kasa	-	-	-
b) Bankalar	111.319	100,00	0,17
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-
C. ALACAKLAR	139.630	-	0,22
a) Takastan Alacaklar Toplamı	-	-	-
i) T1 Alacakları	-	-	-
ii) T2 Alacakları	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Alacakları	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	139.630	-	0,22
i) Diğer Alacaklar	139.630	-	0,22
ii) Vergi Alacakları	-	-	-
iii) Mevduat Alacakları	-	-	-
iv) Temettü	-	-	-
D. BORÇLAR	(837.676)	-	(1,32)
a) Takasa Borçlar	-	-	0,00
i) Takasa Borçlar T1	-	-	-
ii) Takasa Borçlar T2	-	-	-
iii) İleri Valörlü Takas Borçları	-	-	-
iv) İhbarlı FonPay Takas	(598.617,91)	-	-
b) Yönetim Ücreti	(42.354)	5,06	(0,07)
c) Ödenecek Vergi	-	-	-
d) İhtiyatlar	-	0,00	-
e) DİĞER BORÇLAR	(194.793)	23,48	(0,31)
i) Diğer Borçlar	(192.993,73)	-	(0,30)
ii) Denetim Reeskontu	(1.799,26)	-	-
f) Kayda Alma Ücreti	(1.910,69)	0,23	(0,00)
g) Krediler	-	-	-
Fon Toplam Değeri	63.684.237		100,00

Toplam katılma payı/Pay sayısı	100.000.000.000,000
Yatırım Fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	99.104.362.375,508
Fon toplam değeri (TL)	63.684.237,07
Dolaşımdaki pay sayısı (Adet)	895.637.624,492
Birim pay değeri (TL)	<u>0,071105</u>